

~~Biblioteca~~
Audu v

UNIVERSIDAD DE LOS ANDES

FACULTAD DE ECONOMIA

PROGRAMA DE ECONOMETRIA

SEGUNDO SEMESTRE DE 1992

PROF.: DR. ALBERTO MELO GIRALDO

1. OBJETIVOS:

El curso se propone dos objetivos:

- i) Proporcionar a los estudiantes los elementos teóricos fundamentales de la econometría.
- ii) Brindar a los estudiantes la posibilidad de desarrollar una primera experiencia práctica, relativamente intensiva, con las técnicas econométricas relacionadas con el modelo de regresión lineal.

II. CONTENIDOS:

1. El Modelo Lineal General y el estimador de mínimos cuadrados ordinarios.
2. El Modelo Lineal Generalizado.
 - 2.1. El estimador de mínimos cuadrados generalizado.
 - 2.2. Autocorrelación
 - 2.3. Heteroscedasticidad
3. El problema de la multicolinealidad.
4. Variables ficticias.
5. Tendencia y variación estacional en series de tiempo.
6. Modelos de rezagos distribuidos.
7. Pruebas de Especificación y Estabilidad

III. BIBLIOGRAFIA:

No se asigna un texto obligatorio. Como libros de consulta se recomiendan los siguientes:

- 2
1. Judge et. al. *Introduction to the Theory and Practice of Econometrics*.
 2. Greene, *Econometric Theory*

En relación con algunos tópicos específicos se señalarán algunas referencias bibliográficas especializadas.

IV. EVALUACION:

Con la advertencia de que está sujeto a revisión y modificación, el esquema de evaluación es el siguiente:

Dos exámenes parciales	(20% c/u)
Examen final	(25%)
Trabajo empírico	(25%)
Tareas y comprobaciones de lectura	(10%)

Santafé de Bogotá, D.C., 4 de agosto de 1992